

Abstrak

Saham merupakan objek investasi yang diminati oleh banyak pengusaha, baik itu individual maupun suatu perusahaan. Penting sekali untuk mengetahui kondisi saham untuk para pengusaha yang berminat dibidang ini. Karena, apabila kurangnya pengetahuan kondisi suatu saham dapat mengakibatkan resiko kerugian yang cukup tinggi. Untuk itu perlu adanya perhitungan untuk mengetahui kondisi saham, salah satu metodenya yaitu menggunakan *Data Science*. Pada Tugas Akhir ini, dilakukan penelitian terhadap indeks saham tiga negara yaitu, Indeks Indonesia (ISHG/JKSE), Indeks China (SEE) dan Indeks Singapura (SGX). Data yang digunakan adalah data indeks saham perminggu dimulai dari 1 Januari 2006 s/d 31 Desember 2016. Metode yang digunakan dalam Tugas Akhir adalah *Markov Regime Switching Model*. Hasil yang didapatkan adalah kondisi bull ketiga saham terjadi sebanyak 37,46% dan kondisi bear ketiga saham terjadi sebanyak 16,55%.

Kata Kunci : Data Science, Indeks saham, Markov Switching